



El emprendimiento es de todos

Minhacienda

Codigo:

Apo.4.1.4Fr002

Fecha

19/11/2012

Apo.414 Fr.002 Cumplido para Pago

Version


5

PARA: SUBDIRECCION FINANCIERA Y GRUPO DE CONTRATOS

RADICADO No.: CP -

CONS 7

DATOS GENERALES DEL CONTRATO

CONTRATO, ORDEN O CONVENIO No.  .  -   No.Compromiso

NIT O DOCUMENTO DE IDENTIFICACION DEL CONTRATISTA  Radicado: 2-2021-042578

OBJETO DEL CONTRATO, ORDEN O CONVENIO PRESTAR SERVICIOS PROFESIONALES A LA SUBDIRECCION FINANCIERA Y GRUPO DE CONTRATOS DE LA DIRECCION GENERAL DE CRÉDITO PÚBLICO Y TESORO NACIONAL, EN ACTIVIDADES RELACIONADAS CON LA CONSTRUCCIÓN Y PROCESAMIENTO DE ESTADÍSTICAS PARA EL DESARROLLO DE MODELOS Y HERRAMIENTAS CUANTITATIVAS, ASÍ COMO EN LA ELABORACIÓN DE REPORTES Y ANÁLISIS DERIVADOS DE LA GESTIÓN DE LOS RIESGOS FISCALES TANTO DE LA DEUDA PÚBLICA COMO LA ESTRATEGIA DE COBERTURA DE LOS PRECIOS DEL PETRÓLEO

FECHA DE SUSCRIPCION DEL CONTRATO, ORDEN O CONVENIO

NOMBRE CONTRATISTA SAUL EDUARDO BERRIS LAHHOUD

VR CONTRATO MAS ADICIONES	<input type="text" value="30,600,000.00"/>	ADIC	<input type="text" value="0.00"/>	COTR	<input type="text" value="33,600,000.00"/>
---------------------------	--	------	-----------------------------------	------	--

FECHA DE INICIO:

FECHA DE TERMINACION:

TOPE MINIMO DE SEGURIDAD SOCIAL

I.B.C.	SALUD	PENSION	A.R.L.
<input type="text" value="908,526"/>	<input type="text" value="113,600"/>	<input type="text" value="145,400"/>	<input type="text" value="4,700"/>

VALOR PAGADO:  VALOR PENDIENTE POR EJECUTAR:  % EJECUCIÓN:

Adiciones y/o Cesiones del Contrato

Adicion No. 1	Fecha Adicion 25/06/2021	Desde Hasta	Tiempo Adicion	Objeto: OTROSÍ NO. 1 MEDIANTE EL CUAL SE MODIFICAN LAS CLÁUSULAS SEGUNDA PLAZO DE EJECUCIÓN, TERCERA VALOR TOTAL DEL CONTRATO Y QUINTA IMPUTACIÓN PRESUPUESTAL DEL CONTRATO DE PRESTACIÓN DE SERVICIOS NO. 3.108-2021. NUEVO PLAZO HASTA EL 30 DE NOVIEMBRE DE 2021, INCLUSIVE. NUEVO VALOR CTTO HASTA POR LA SUMA DE \$30.600.000,00 MONEDA CORRIENTE.
Cesion 1	Fecha: 21/07/2021	Observacion: CESION DEL CONTRATO NO 3.108-2021 DE HEIDY NATALI TRIVIÑO MORENO A SAUL EDUARDO BERRIS LAHHOUD, TENIENDO COMO FECHA DE INICIO SEGÚN APROBACIÓN DE PÓLIZA EL 23 DE JULIO DEL 2021		

DATOS ESPECIFICOS DEL PAGO

Tipo de Pago	No.	Condicion de Pago	Aclaracion	Vr.Pago	Iva Aplicado	Valor Iva	Amor Anticipada	Total a Pagar
FORME NO.	7	PERIODO	PERIODO COMPRENDIDO ENTRE EL 23 Y 31 DE JULIO DE 2021	800,000.00	0 %	.00		800,000.00
TOTALES				800,000.00		.00		

TOTAL A PAGAR

PERIODO PAGADO - APORTES SEGURIDAD SOCIAL JULIO DEL AÑO 2021

PLANILLA No.

Anexos y No. de Folios

Factura	<input type="text"/>	Cuenta de Cobro	<input type="text"/>	Declaracion juramentada Seguridad Social	<input type="text" value="1"/>
Otros Anexos o Folios	<input type="text" value="2"/>	Entrada a Almacen	<input type="text"/>	Constancias de pago de la seguridad social	<input type="text" value="1"/>
				Total de Folios Anexos	<input type="text" value="4"/>

En calidad de Supervisor/Interventor del contrato enunciado, certifico que he verificado el cumplimiento a satisfaccion de las obligaciones que emanan del contrato, la acreditacion del pago de obligaciones con el sistema de seguridad social integral y las cifras y valores correspondientes al periodo certificado para el reconocimiento del pago que por este instrumento se acredita

Se firma a los 18 dias del mes de Agosto del año 2021

SUPERVISORES Y/O INTERVENTORES


FIRMA:  
NOMBRE: SANTIAGO RODRIGUEZ MENDEZ  
CARGO: ASESOR  
CEDULA: 1032410363

Firmado digitalmente por:SANTIAGO RODRIGUEZ MENDEZ

Asesor

oh3j U1A1 czoG nuaU DvB4 7pVo esE=

Validar documento firmado digitalmente en: http://sedelectronica.minhacienda.gov.co

 El emprendimiento es de todos    Minhacienda	<b>Informe de Ejecución y Supervisión de Contrato</b>	Código:	Apo.4.1.Fr.16
		Fecha:	22-03-2019
		Versión:	3
		Página:	1 de 3

## CONTENIDO DEL INFORME

1.	Condiciones del Contrato .....	1
2.	Objeto del Contrato.....	1
3.	Obligaciones del Contrato, Actividades Ejecutadas y Productos Entregados.....	1

### 1. CONDICIONES DEL CONTRATO

Número de Contrato: 3.108-2021  
 Nombre del Contratista: **SAÚL EDUARDO BERRIS LAHHOUD**  
 Periodo informe: del 23 de julio al 31 de julio  
 Supervisor: Jaime Orlando Gaona Sánchez  
 Área perteneciente: Dirección de Crédito Público y Tesoro Nacional- Subdirección de Riesgo


### 2. OBJETO DEL CONTRATO

Prestar servicios profesionales a la Subdirección de Riesgo de la Dirección General de Crédito Público y Tesoro Nacional, en actividades relacionadas con la construcción y procesamiento de estadísticas para el desarrollo de modelos y herramientas cuantitativas, así como en la elaboración de reportes y análisis derivados de la gestión de los riesgos fiscales tanto de la deuda pública como la estrategia de cobertura de los precios de petróleo.

### 3. OBLIGACIONES DEL CONTRATO, ACTIVIDADES EJECUTADAS Y PRODUCTOS ENTREGADOS

Las obligaciones adquiridas son las siguientes:

<p>1. Proponer herramientas cuantitativas que permitan producir información significativa para la automatización de procesos de cálculo, generación de reportes y actualización de bases de datos, a partir de hojas de cálculo y paquetes informáticos como "R Studio" y "Stata". Entre otros, en el marco de la gestión de riesgos, tanto de la deuda pública como de la estrategia de cobertura de los precios del petróleo.</p> <p>Se avanzó en la investigación para implementar el cálculo de ajuste de distribución disponible en el complemento de Excel "Risk Simulator" con el estadístico Kolmogorov-Smirnov en el lenguaje estadístico "R" para tener a disposición más flexibilidad, mayor velocidad computacional y más opciones de distribuciones de probabilidad en los análisis estadísticos necesarios para la gestión de riesgos.</p>
<p>2. Apoyar la elaboración de informes de evaluación sobre derivados financieros existentes en el mercado, susceptibles de implementarse en operaciones de deuda o cobertura de los precios del petróleo.</p> <p>Se apoyó en la elaboración del informe Cross Currency Swap, este informe se realiza con frecuencia semanal evaluando una ventana de oportunidad para convertir los créditos tasa fija en dólares a moneda local, se descarga y cálculo en Bloomberg de la curva swap para créditos bullet y amortizables según los nodos, se hace la interpolación de las curvas de rendimientos y se evalúa cuales créditos pueden ser susceptibles de conversión a moneda local según su margen, se calculan los swaps tasa fija de cada uno de los créditos y se</p>

 <b>El emprendimiento es de todos</b> <b>Minhacienda</b>	<b>Informe de Ejecución y Supervisión de Contrato</b>	Código:	Apo.4.1.Fr.16
		Fecha:	22-03-2019
		Versión:	3
		Página:	2 de 3

comparan con sus respectivos límites, evidenciando cuantos puntos básicos se encuentran por debajo o por encima de la curva, se analiza indicadores como devaluaciones, volatilidad .

Ruta: Z:\Deuda\Informes\No Periódicos\Solicitud cesar\Break Even\_TRM\CCS 2021

3. Apoyar la realización de exámenes detallados sobre el impacto de variables macro y los precios del petróleo en las finanzas de la Nación y su relación con los riesgos fiscales.

No se requiere a la fecha.

4. Participar en la elaboración de informes de investigación relacionados con el comportamiento de los diferentes indicadores que influyen en el mercado de la deuda y el petróleo.

No se requiere a la fecha.

5. Recopilar, construir, procesar y consolidar estadísticas, así como elaborar informes relacionados con el documento de política de deuda de la Nación y coberturas de los precios del petróleo.

Se actualizó y realizó el envío semanal del gráfico de las disponibilidades de la Dirección del Tesoro Nacional – DTN en el Banco de la República de 2017 a 2021, que incluye depósitos no remunerados, depósitos remunerados e intereses de depósitos remunerados.

Se apoyó en la actualización del análisis emisión de TES. Se calculó el Pain Threshold entre la alternativa de financiamiento local mediante emisión de bonos en COP y UVR, y financiamiento externo mediante emisión de bonos globales externos y créditos multilaterales, se evaluaron escenarios donde se estresó el yield del bono en 90%, 95% y 99%, así como se realizó la simulación de Montecarlo estresando la tasa de cambio en diferentes niveles y evaluando los niveles de certeza al 90%, 95, y 99%.

Ruta: Z:\Deuda\Informes\No Periodicos\Pain Threshold

6. Brindar apoyo en la elaboración de documentos (presentaciones en PowerPoint, memorandos, oficios, etc.) e informes relacionados con endeudamiento público, riesgos fiscales y en general lo que requiera la Dirección General de Crédito Público y Tesoro Nacional.

Avance en la elaboración del concepto de AFD EUR€ 200 millones, evaluando tasas de interés, vida media, índice de concentración y valor presente de los intereses de las diferentes alternativas para obtener las mejores condiciones de financiamiento según los riesgos fiscales de la deuda pública.

Se dio repuesta a la solicitud de concepto técnico por parte de la Subdirección Jurídica sobre el monto total de deuda bruta del Gobierno Nacional Central entre los años 1992 y 2020.

Ruta: Z:\Deuda\Conceptos\Conceptos\Multilaterales\2021\kFW 100 millones


7. Asistir a las reuniones que el supervisor del contrato determine y que estén relacionados con el objeto del contrato.

Asistencia a las reuniones semanales que se llevan a cabo en la Coordinación de pasivos de la Nación para revisar las tareas y cumplimientos de la semana.

8. Mantener la confidencialidad o reserva necesaria en el desarrollo de sus labores.

• Cumplido

9. Presentar los informes que se requiera a través de la supervisión del contrato, relacionados con el objeto contractual.

 El emprendimiento es de todos    Minhacienda	<b>Informe de Ejecución y Supervisión de Contrato</b>	Código:	Apo.4.1.Fr.16
		Fecha:	22-03-2019
		Versión:	3
		Página:	3 de 3

<ul style="list-style-type: none"> <li>• Cumplido</li> </ul>
10. Cumplir con las demás actividades propias de la ejecución del objeto del contrato y que sean asignadas por el Supervisor del mismo.
<ul style="list-style-type: none"> <li>• Cumplido</li> </ul>



\_\_\_\_\_  
FIRMA CONTRATISTA

En mi calidad de supervisor del contrato me permito avalar el contenido del informe y el avance en la ejecución del mismo de acuerdo a lo descrito.

El contrato no presenta a la fecha dificultades en su ejecución, ni situaciones exógenas que afecten el normal desarrollo del mismo.



\_\_\_\_\_  
FIRMA SUPERVISOR